

Предупреждение об использовании Биржевой информации на Срочном рынке АРМ-автоматизированное рабочее место, подключенное к Торговой системе

Биржа – ПАО Московская биржа

Биржевая информация – цифровые данные и иные сведения неконфиденциального характера о ходе и итогах торгов на Бирже, а также информационные сообщения Биржи, обработанные и систематизированные с помощью программно-технических средств и оборудования Биржи, содержащиеся в базах данных Биржи, правом на использование которых обладает Биржа в соответствии с законодательством Российской Федерации

Клиент – зарегистрированное Биржей в установленном порядке юридическое или физическое лицо, резидент или нерезидент, которое является:

- клиентом Расчетной фирмы, или
- клиентом юридического лица, обладающего лицензией профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности и(или) деятельности по управлению ценными бумагами и являющегося клиентом Расчетной фирмы, или

клиентом иностранного юридического лица, учрежденного в одном из государств, указанных в подпунктах 1 и 2 пункта 2 статьи 51.1. Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», и имеющего право в соответствии с личным законом осуществлять брокерскую деятельность, и являющегося клиентом Расчетной фирмы, по поручению и за счет которого Расчетной фирмой совершаются Срочные сделки;

Правила - Правила организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа (с изменениями и дополнениями).

Расчетная фирма (Участник торгов) - ТКБ БАНК ПАО

В соответствии с требованием Правил организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская биржа Расчетная фирма предупреждает Клиента о видах информации, получаемой от Биржи Расчетной фирмой, о целях в которых Расчетная фирма и/или Клиент может использовать Биржевую информацию, а также о мерах ответственности Клиента за нарушение целей использования Биржевой информации.

1. В соответствии с Правилами организованных торгов на Срочном рынке ПАО «Московская биржа» Биржа в течение Торгов предоставляет через АРМ всем Расчетным фирмам следующую Биржевую информацию:

- о расписании Торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа;
- о Фьючерсах и Опционах, которые могут заключаться на Бирже;
- о ценах и объемах Заявок на покупку и Заявок на продажу по Фьючерсам с каждым базовым активом и датой исполнения и Опционам каждой Серии, а также о величине спредов и объемах Заявок “Календарный спред”;
- о зарегистрированных в Реестре сделок в ходе текущего Торгового дня Срочных сделках (время регистрации Срочной сделки, цена по Фьючерсам и значения премии по Опциону, объем Срочной сделки) по Фьючерсам с каждым базовым активом и датой исполнения и Опционам каждой Серии;
- объявления Администратора и иные информационные сообщения.

2. Каждой Расчетной фирме в течение Торгового дня Биржа предоставляет через АРМ доступ к информации:
- о Срочных сделках, совершенных от ее имени в ходе текущего Торгового дня (время регистрации Срочной сделки, цена по Фьючерсу или премия по Опциону, объем, код раздела регистра учета позиций);
 - о размерах средств, которые Участник торгов может использовать для проведения торговых операций на Срочном рынке;
 - о текущем размере вариационной маржи по позициям Участника торгов.

3. В течение Торгового дня Биржа через АРМ всем Расчетным фирмам предоставляет в режиме реального времени следующую Биржевую информацию:

3.1. Обо всех безадресных Заявках, объявленных Участниками торгов в Торговую систему на Срочном рынке ПАО Московская Биржа в ходе текущего Торгового дня. Информация о безадресных Заявках раскрывается без указания сведений об Участнике торгов, объявившем Заявку, и Клиенте, по поручению которого она объявлена (в том числе сведений о присвоенных им кодах);

3.2. По Фьючерсам (по Фьючерсам каждого вида и срока исполнения):

- обозначение Фьючерса;
- минимальное и максимальное значение цен в зарегистрированных на данный момент Срочных сделках;
- цены лучших Заявок на покупку, лучших Заявок на продажу, зарегистрированных в Реестре заявок;
- цена в последней зарегистрированной Срочной сделке;
- изменение цены последней Срочной сделки;
- количество совершенных Срочных сделок;
- оборот с начала текущего Торгового дня (контрактов).

а. По Опционам (по Опционам каждой Серии):

- обозначение Опциона;
- минимальное и максимальное значение премии в зарегистрированных на данный момент Срочных сделках;
- премии в лучших Заявках на покупку и продажу, зарегистрированных в Реестре заявок;
- премия в последней зарегистрированной Срочной сделке;
- изменение премии последней Срочной сделки;
- количество совершенных Срочных сделок;
- оборот с начала текущего Торгового дня (контрактов).

4. Указанная в пунктах 1 – 3 настоящего Предупреждения информация, включая Биржевую информацию, предоставляется Расчетным фирмам для целей, необходимых для участия Расчетной фирмы в Торгах, а именно для совершения Срочных сделок в интересах Расчетной фирмы и/или её Клиентов, ведения внутреннего учета и сверки расчетов, необходимых для обеспечения участия в Торгах.

5. Использование Расчетной фирмой и/или её Клиентами Биржевой информации в иных целях, отличных от указанных в пункте 4 настоящего Предупреждения, включая, но не ограничиваясь, использованием Биржевой информации:

- в системах автоматического принятия решений о заключении Срочных сделок (в том числе с использованием торговых алгоритмов);
- в системах риск-менеджмента;
- для расчета Производной информации;
- для распространения Биржевой информации неограниченному кругу лиц;
- для предоставления Биржевой информации третьим лицам,

возможно только при условии заключения договора с Биржей и в соответствии с Порядком использования биржевой информации Биржи.

Данное требование не применяется:

- к предоставлению Биржевой информации Участником торгов своему Клиенту в ходе Торгов в объеме, необходимом для принятия решения о совершении Срочных сделок, а также об итогах торгов в отношении сделок, совершенных в интересах этого Клиента;
- к использованию Биржевой информации для расчета Производной информации в случаях, предусмотренных Порядком использования биржевой информации Биржи;
- к распространению/предоставлению Биржевой информации новостного и уведомительного характера (новости, объявления, информация о событиях и мероприятиях).

6. В случае нарушения Клиентом Расчетной фирмы пункта 5 настоящего Предупреждения, Расчетная фирма обязана применить к Клиенту одну из следующих мер ответственности:

- предупреждение о нарушении в письменном виде;
- приостановка предоставления Клиенту Биржевой информации до устранения допущенных Клиентом нарушений в отношении использования Биржевой информации.

ТКБ БАНК ПАО рекомендует Клиенту ознакомиться в полном объеме с Правилами организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа.

Клиент ознакомлен с Предупреждением:

_____ / _____

Дата «__» _____ 20__

Предупреждение об использовании Биржевой информации на Фондовом рынке.

Термины и определения:

Биржа, Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС» (ПАО Московская биржа)

Биржевая информация – цифровые данные и иные сведения неконфиденциального характера о ходе и итогах торгов на Московской бирже (включая торговый код ценной бумаги, величину стандартного лота, шага цены ценной бумаги и иные подобные условия проведения торгов ценной бумагой. Установленные решением Биржи), раскрываемые (предоставляемые) в режиме реального времени, с задержкой или в виде итогов торгов, обработанные и систематизированные с помощью программно-технических средств и оборудования Московской Биржи, содержащиеся в базах данных Московской биржи.

Правила- Правила проведения торгов на фондовом рынке Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» (с изменениями и дополнениями).

Клиент - юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в Системе торгов ПАО Московская биржа на основании данных, полученных от участника торгов ПАО Московская биржа или от Клиринговой организации.

Участник торгов - ТКБ БАНК ПАО

1. В соответствии с Правилами проведения торгов на фондовом рынке Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» (с изменениями и дополнениями) Участник торгов предупреждает Клиента, что Клиент может использовать Биржевую информацию исключительно в целях участия в торгах (принятия решения о выставлении/невыващении заявки, объявления (подачи) заявок Участнику торгов для заключения сделок с ценными бумагами на Бирже, ведения в системах бэк-офиса учета заключенных за счет Клиента сделок), а также о мерах ответственности за нарушения при использовании Биржевой информации.

2. В соответствии с Правилами Биржа является обладателем всей информации, связанной с ходом и итогами торгов (торговых сессий) на Бирже. Участники торгов используют предоставленную Биржей Биржевую информацию для целей участия в торгах (принятия решения о выставлении/невыващении заявок, объявления (подачи) заявок и совершения (заключения) сделок с ценными бумагами, ведения в системах бэк-офиса учета сделок, сверки, расчетов, необходимых для обеспечения участия в торгах) на Бирже. Для использования Участниками торгов Биржевой информации в системах автоматического принятия решения о выставлении/невыващении заявок, объявления (подачи) заявок и совершения (заключения) сделок с ценными бумагами) на Бирже, в т.ч. с использованием торговых алгоритмов, а также для использования Биржевой информации в системах риск-менеджмента требуется заключение

договора с ПАО Московская Биржа. Любое иное использование Биржевой информации возможно только при условии заключения договора с ПАО Московская Биржа и в соответствии с положениями «Порядка использования Биржевой информации, предоставляемой ПАО Московская Биржа».

3. Не является нарушением Правил предоставление Участником торгов своему Клиенту Биржевой информации в объеме, необходимом для целей участия в торгах, приведенных в пункте 1 настоящего Предупреждения (пункт 1. 13.9 Правил), а также Биржевой информации об итогах торгов в отношении сделок, совершенных в интересах этого Клиента. Использование Участниками торгов Биржевой информации в иных целях, не связанных с участием в торгах на Бирже, в том числе для расчета производных показателей (цифровые данные, в том числе индексы и индикаторы, рассчитанные на основе Биржевой информации), с целью их дальнейшего распространения или в иных целях, не предусмотренных настоящими Правилами, не допускается без заключения договора с ПАО Московская Биржа.

Упомянутое в настоящем пункте требование обязательного заключения с ПАО Московская Биржа договора на использование Биржевой информации в целях, не связанных с участием в торгах на Бирже, не применяется в отношении Участников торгов категории «А», если такое использование Биржевой информации осуществляется ими в рамках функций, возложенных на таких Участников торгов законодательством Российской Федерации.

Состав раскрываемой Биржей Участникам торгов информации, связанной с ходом и итогами торгов на Бирже, предусмотрен требованиями законов и иных нормативных правовых актов Российской Федерации, иных нормативных правовых актов Российской Федерации и внутренними документами Биржи.»

4. В случае использования Клиентом Биржевой информации в целях, отличных от целей участия в торгах (принятия решения о выставлении/невыставлении заявки, объявления (подачи) заявок Участнику торгов для заключения сделок с ценными бумагами на Бирже, ведения в системах бэк-офиса учета заключенных за счет Клиента сделок), Участник торгов обязан применить к Клиенту одну из следующих мер ответственности:

- Предупреждение о нарушении использования Биржевой информации в письменном виде;
- Приостановление предоставления Клиенту Биржевой информации до устранения допущенных Клиентом нарушений в отношении использования Биржевой информации;
- Прекращение предоставления Клиенту Биржевой информации.»

ТКБ БАНК ПАО рекомендует Клиенту ознакомиться в полном объеме с Правилами проведения торгов на фондовом рынке Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС»

Клиент ознакомлен с Предупреждением:

_____ / _____

Дата «__» _____ 20__